

HSBC Portföy Çoklu Varlık Üçüncü Değişken Fon

**1 Ocak - 31 Aralık 2019 hesap dönemine ait
Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden
Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık
Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata
Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Denetim Raporu**

HSBC Portföy Çoklu Varlık Üçüncü Değişken Fon'un Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor

HSBC Portföy Çoklu Varlık Üçüncü Değişken Fon'un pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

HSBC Portföy Çoklu Varlık Üçüncü Değişken Fon'un pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve HSBC Portföy Yönetimi Anonim Şirketi'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

Güney Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.
A member firm of Ernst & Young Global Limited

Fatih Polat, SMMM
Sorumlu Denetçi

22 Nisan 2020
İstanbul, Türkiye

HSBC Portföy Çoklu Varlık Üçüncü Değişken Fon

31 Aralık 2019 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu (Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

HOA - HSBC PORTFÖY ÇOKLU VARLIK ÜÇÜNCÜ DEĞ. FON															
02/01/2020 08:55															
HOA - HSBC PORTFÖY ÇOKLU VARLIK ÜÇÜNCÜ DEĞ. FON 31 Aralık 2019 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR															
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Yabancı															
SXSEEX	EUR	ISHARES, INC			2.300,00	35,39	25/11/19				37,82	579.509,43	11,49	3,49	3,51
SYBM	EUR	State StreetBank and Trust Company			2,00	67,61	18/10/19				65,81	876,84	0,02	0,01	0,01
GRUP TOPLAMI					2.302						580.386,27		11,51	3,5	3,52
Hisse Türk															
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			44.800,00	7,38	18/10/19				8,11	363.328,00	7,20	2,19	2,20
ANHYT	TL	ANADOLU HAYAT EMEKLİLİK A.Ş.			0,90	5,31	18/10/19				6,84	6,17	-	-	-
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.			1.850,00	21,95	18/10/19				20,84	38.554,00	0,76	0,23	0,23
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			4.220,00	21,17	18/10/19				20,94	88.366,80	1,75	0,53	0,54
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.			4.610,00	32,12	18/10/19				46,66	215.102,60	4,26	1,30	1,30
ENKAİ	TL	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.S.			1,01	4,79	18/10/19				6,42	6,45	-	-	-
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş			24.600,00	7,89	18/10/19				9,04	222.384,00	4,41	1,34	1,35
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			33.000,00	9,46	18/10/19				11,14	367.620,00	7,29	2,22	2,23
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			11.700,00	3,07	04/11/19				8,02	93.834,00	1,86	0,57	0,57
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			0,47	1,21	18/10/19				1,76	0,83	-	-	-
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			6.950,00	13,79	18/10/19				20,32	141.224,00	2,80	0,85	0,86
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.			1.800,00	36,86	18/10/19				74,05	133.290,00	2,64	0,80	0,81
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			0,57	4,02	18/10/19				2,66	1,50	-	-	-
PETKM	TL	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.			12.800,00	3,51	18/10/19				3,81	48.768,00	0,97	0,29	0,30
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			1.500,00	26,42	18/10/19				86,40	129.600,00	2,57	0,78	0,79
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			13.200,00	10,78	18/10/19				9,54	125.928,00	2,50	0,76	0,76
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			1,70	3,47	18/10/19				5,27	8,97	-	-	-
SODA	TL	SODA SANAYİLİ A.Ş.			8.712,12	4,86	18/10/19				6,18	53.840,90	1,07	0,32	0,33
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			18.000,00	12,79	18/10/19				13,80	248.400,00	4,92	1,50	1,51
THYAO	TL	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			8.850,00	11,67	18/10/19				14,46	127.971,00	2,54	0,77	0,78
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			4.000,00	23,36	18/10/19				19,32	77.280,00	1,53	0,47	0,47
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			1.710,00	26,91	18/10/19				26,86	45.930,60	0,91	0,28	0,28
TRKCM	TL	TRAKYA CAM SANAYİLİ A.Ş.			13,91	4,05	18/10/19				3,50	48,69	-	-	-
TSKB	TL	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.			1,10	1,41	18/10/19				1,21	1,34	-	-	-
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.			11.600,00	3,93	18/10/19				7,37	85.492,00	1,69	0,51	0,52
TUPRS	TL	TUPRAS-TÜRKİYE PETROL RAFİNELERİ A.S.			1.540,00	98,62	18/10/19				126,80	195.272,00	3,87	1,18	1,18
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			40.000,96	2,04	18/10/19				2,48	99.202,38	1,97	0,60	0,60
GRUP TOPLAMI					255.463						2.901.462,23		57,51	17,49	17,61
Hisse Yabancı															
EEM	USD	ISHARES, INC			365,00	46,11	18/10/19				44,87	97.282,65	1,93	0,59	0,59
EMB	USD	ISHARES, INC			100,00	113,65	18/10/19				114,56	68.048,64	1,35	0,41	0,41
EMLC	USD	VanEck Vectors J.P. Morgan EM			1.000,00	38,96	18/10/19				34,01	202.019,40	4,00	1,22	1,22
EWJ	USD	ISHARES, INC			480,00	61,43	18/10/19				59,24	168.905,09	3,35	1,02	1,02
HYG	USD	ISHARES, INC			40,00	82,03	18/10/19				87,94	20.894,54	0,41	0,13	0,13
LEMB	USD	ISHARES, INC			150,00	49,80	18/10/19				43,89	39.105,99	0,78	0,24	0,24
PRF	USD	Invesco PowewrShares Capital Mgmt LLC			80,00	74,13	18/10/19				126,71	60.212,59	1,19	0,36	0,37
PXH	USD	Invesco PowewrShares Capital Mgmt LLC			3.000,00	19,23	18/10/19				22,30	397.386,00	7,88	2,40	2,41
VCSH	USD	VANGUARD GROUP			80,00	79,29	18/10/19				81,03	38.505,46	0,76	0,23	0,23
VOO	USD	VANGUARD GROUP			80,00	266,90	18/10/19				295,80	140.564,16	2,79	0,85	0,85
VVO	USD	VANGUARD GROUP			1.250,00	39,68	18/10/19				44,47	330.189,75	6,54	1,99	2,00
GRUP TOPLAMI					6.625						1.563.114,27		30,98	9,44	9,47
GRUP TOPLAMI					264.390						5.044.962,77		100	30,43	30,6
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvil															
TRT220921T18	TL	HAZİNE	22/09/21	0	1.000.000,00	97,67	02/12/19		721544068958302981		99,31	993.097,72	18,02	5,98	6,02
TRT120122T17	TL	HAZİNE	12/01/22	8,0404	300.000,00	105,35	18/10/19				101,17	303.510,60	5,51	1,83	1,84
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/08/23	4,0718	200.000,00	96,85	18/10/19				200,13	400.256,75	7,27	2,41	2,43
TRT270923T11	TL	HAZİNE	27/09/23	8,223	300.000,00	102,30	18/10/19				94,31	282.929,00	5,14	1,71	1,72
TRT200324T13	TL	HAZİNE	20/03/24	7,8166	300.000,00	110,18	18/10/19				99,20	297.614,71	5,40	1,79	1,80
TRT110226T13	TL	HAZİNE	11/02/26	15,1124	100.000,00	83,64	07/11/19				97,98	97.979,65	1,78	0,59	0,59
GRUP TOPLAMI					2.200.000						2.375.388,43		43,12	14,31	14,4
Özel Sektör															
Özel Sektör Tahvil															
TRSAKFH12015	TL	AKFEN HOLDİNG A.Ş.	06/01/20	16,1364	300.000,00	100,83	18/10/19				104,19	312.570,28	5,67	1,88	1,90
TRSAYGZ12024	TL	AYGAZ A.Ş.	24/01/20	28,9072	300.000,00	100,00	18/10/19				106,21	318.643,00	5,78	1,92	1,93
TRSO TKO22012	TL	OTOKOÇ OTOMOTIV TİC VE SAN A.Ş.	26/02/20	50,1633	300.000,00	100,00	18/10/19				104,88	314.634,41	5,71	1,90	1,91
TRSAKFH32013	TL	AKFEN HOLDİNG A.Ş.	19/03/20	18,6636	100.000,00	100,00	18/10/19				100,79	100.788,34	1,83	0,61	0,61
TRSKCTF32014	TL	KOÇ FİNANSMAN A.Ş.	23/03/20	17,9126	380.000,00	100,00	18/10/19				103,97	395.075,54	7,17	2,38	2,40
TRFTCZB82013	TL	TC ZİRAAT BANKASI	27/08/20	20,916	260.000,00	100,00	18/10/19				102,25	265.857,99	4,83	1,60	1,61

HSBC Portföy Çoklu Varlık Üçüncü Değişken Fon

31 Aralık 2019 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

HOA - HSBC PORTFÖY ÇOKLU VARLIK ÜÇÜNCÜ DEĞ. FON															
02/01/2020 08:55															
HOA - HSBC PORTFÖY ÇOKLU VARLIK ÜÇÜNCÜ DEĞ. FON 31 Aralık 2019 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR															
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
TRSORFNE2019	TL	ORFIN FINANSMAN	30/10/20	25,53	400.000,00	100,00	18/10/19				102,99	411.975,35	7,48	2,48	2,50
TRISISGY32111	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	23/03/21	17,508	360.000,00	100,00	18/10/19				100,25	360.908,38	6,55	2,18	2,19
TRSENSA32314	TL	ENERJISA ENERJİ A.Ş.	30/03/23	5,065	500.000,00	100,00	18/10/19				130,65	653.240,72	11,86	3,94	3,96
GRUP TOPLAMI					2.900.000						3.133.694,01		56,88	18,89	19,01
GRUP TOPLAMI					2.900.000						3.133.694,01		56,88	18,89	19,01
GRUP TOPLAMI					5.100.000						5.509.082,44		100	33,2	33,41
T.REPO															
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/20	11,25	5.003.082,19	11,25	31/12/19	2.567.545,00	722810706353284837	5.003.082,19	11,38	5.003.082,19	100,00	30,13	30,34
GRUP TOPLAMI					5.003.082						5.003.082,19		100	30,13	30,34
GRUP TOPLAMI					5.003.082						5.003.082,19		100	30,13	30,34
MEVDUAT															
TEB A.Ş.	EUR		10/01/20	0,1	40.000,44		09/12/19			40.003,95	0,10	266.504,47	100,00	1,61	1,62
GRUP TOPLAMI					40.000						266.504,47		100	1,61	1,62
GRUP TOPLAMI					40.000						266.504,47		100	1,61	1,62
TPP															
TPP			02/01/20	10,8	390.230,79	10,80	31/12/19		228533	390.230,79	10,78	390.230,79	100,00	2,35	2,37
GRUP TOPLAMI					390.231						390.230,79		100	2,35	2,37
GRUP TOPLAMI					390.231						390.230,79		100	2,35	2,37
TÜREV															
Futures															
Kısa															
F_USDTRY0120	TL				60,00	5,99	30/12/19		80176126522782630		6,00	360.042,00	-	-	-
F_XU0300220	TL				15,00	141,30	30/12/19		801701261212518790		141,30	211.950,00	-	-	-
F_EURUSD0120	USD				58,00	1,12	31/12/19		80176126523231610		1,12	387.412,74	-	-	-
GRUP TOPLAMI					133						959.404,74		-	-	-
GRUP TOPLAMI					133						959.404,74		-	-	-
VIOP Nakit															
Teminatl															
VIOP Nakit Teminatl					377.990,19							377.990,19	100,00	2,28	
GRUP TOPLAMI					377.990						377.990,19		100	2,28	
GRUP TOPLAMI					377.990						377.990,19		100	2,28	
DİĞER															
Döviz															
EUR	EUR	EU			2.301,26	6,39	31/12/19				6,66	15.331,22	-	-	0,09
USD	USD	FED			8.865,24	5,79	31/12/19				5,94	52.659,53	-	-	0,32
GRUP TOPLAMI					11.167						67.990,75		-	-	0,41
GRUP TOPLAMI					11.167						67.990,75		-	-	0,41
FON PORTFÖY DEĞERİ											16.591.852,85			100,00	

HSBC Portföy
Çoklu Varlık Üçüncü Değişken Fon

31 Aralık 2019 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

31 Aralık 2019			
	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%
Fon portföy değeri	16.591.853	100%	101%
Hazır değerler	86.343	100%	1%
Kasa	-	-	-
Bankalar	18.352	-	-
Diğer hazır değerler	67.991	79%	0,41%
Alacaklar	-	-	0,00%
Takastan alacaklar	-	-	-
Diğer alacaklar	-	-	0,00%
Borçlar	(186.605)	100%	-1,13%
Banka kredileri	-	-	-
İhbarlı FonPay Takas	(150.450)	80,62%	-0,91%
Takasa Borçlar	-	0,00%	0,00%
Fon yönetim ücretleri	(20.882)	11,19%	-0,13%
Denetim ücreti	(557)	0,30%	0,00%
Diğer borçlar	(13.891)	7,44%	-0,08%
Kayda Alma Ücreti	(825)	0,44%	-0,01%
Fon toplam değeri	16.491.591	100%	100%